

东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划清算报告

管理人：东莞证券股份有限公司

托管人：中国证券登记结算有限责任公司

报告出具日期：2025 年 9 月 18 日

报告公告日期：2025 年 10 月 15 日

一、重要提示

东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”、“集合计划”）原为旗峰天添利集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），于 2012 年 12 月 21 日成立。根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，中国证监会已完成对原集合计划的规范验收并批准了合同变更。自 2022 年 8 月 26 日起，《东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）生效，原《旗峰天添利集合资产管理合同》同日起失效。本集合计划管理人为东莞证券股份有限公司，托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《资产管理合同》第十九部分“合同的变更、终止与集合计划财产的清算”约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：3、《资产管理合同》约定的其他情形”；第三部分“集合计划的基本情况”约定：“本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年”，本集合计划（产品代码：970176）截至 2025 年 8 月 25 日存续期限届满，触发《资产管理合同》约定的终止情形，《资产管理合同》应当终止，并无需召开集合计划份额持有人大会，本集合计划进入清算程序。

本集合计划从 2025 年 8 月 26 日起进入清算程序，由管理人东莞证券股份有限公司、托管人中国证券登记结算有限责任公司、大信会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序，并由大信会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、集合计划情况

1、集合计划基本情况

名称	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划
简称	东莞证券旗峰天添利货币
主代码	970176
运作方式	契约型开放式
合同生效日	2022年08月26日
管理人	东莞证券股份有限公司
托管人	中国证券登记结算有限责任公司
最后运作日份额总额	1,771,867,791.85份
合同存续期	本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3 年。

2、产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	本集合计划在确保资产安全性和流动性的基础上，对短期货币市场利率的走势进行预测和判断，采取积极主动的投资策略，综合利用定性分析和定量分析方法，力争获取超越比较基准的投资回报。 1、资产配置策略； 2、信用债投资策略； 3、久期管理策略； 4、债券回购策略； 5、流动性管理策略。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划

最后运作日：2025 年 8 月 25 日

单位：人民币元

资产	
银行存款	1,765,205,197.12
结算备付金	9,865,995.62
存出保证金	74,974.92
资产合计	1,775,146,167.66
负债及所有者权益	
负 债	
应付管理人报酬	501,780.39
应付托管费	83,630.09
应交税费	10,721.18
应付利润	2,470,444.80
其他负债	211,799.35
负债合计	3,278,375.81
所有者权益	
实收基金	1,771,867,791.85
未分配利润	0.00
所有者权益合计	1,771,867,791.85
负债及所有者权益总计	1,775,146,167.66
份额净值	1.0000

注：截至集合计划最后运作日 2025 年 8 月 25 日，本集合计划单位净值为 1.0000，
份额总额为 1,771,867,791.85 份。

四、清算报表附注

1、集合计划基本情况

东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为旗峰天添利集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），于 2012 年 12 月 21 日成立。根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等规定和中国证券监督管理委员会《关于准予旗峰天添利集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2022〕646 号文）的要求，以及《旗峰天添利集合资产管理合同》和《旗峰天添利集合资产管理计划说明书》的约定，东莞证券股份有限公司（以下简称“管理人”）作为原集合计划的管理人，经与托管人中国证券登记结算有限责任公司协商一致，将旗峰天添利集合资产管理计划变更为东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划，并按照《旗峰天添利集合资产管理合同》和《旗峰天添利集合资产管理计划说明书》的有关约定履行法律文件变更程序。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，中国证监会已完成对原集合计划的规范验收并批准了合同变更。自 2022 年 8 月 26 日起，《东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）生效，原《旗峰天添利集合资产管理合同》同日起失效。

根据东莞证券股份有限公司于 2025 年 8 月 25 日发布的《关于东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划资产管理合同终止及财产清算的公告》，本集合计划自 2025 年 8 月 26 日起进入清算程序。

2、清算原因

《资产管理合同》第十九部分“合同的变更、终止与集合计划财产的清算”约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：3、《资产管理合同》约定的其他情形”；第三部分“集合计划的基本情况”约定：“本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年”。

根据前述约定，本集合计划于2025年8月25日已触发《资产管理合同》约定的终止事由，《资产管理合同》应当终止，本集合计划进入清算程序。

3、清算起始日

本集合计划清算起始日为2025年8月26日。

4、清算报表编制基础

本集合计划的清算报表系本集合计划为集合计划财产清算而向中国证监会备案及公告清算报告之目的而编制。基于此目的，清算报表系本集合计划财产清算小组在非持续经营基础上，参照《企业会计准则》及其相关规定、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《资产管理合同》的有关规定编制的。自本集合计划最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自2025年8月26日至2025年8月27日止的清算期间，集合计划财产清算小组对本集合计划的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《资产管理合同》“第十九部分 合同的变更、终止与集合计划财产的清算”的约定，清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，依据《资产管理合同》，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

2、 资产处置情况

最后运作日银行存款为人民币 1,765,205,197.12 元、结算备付金为人民币 9,865,995.62 元、存出保证金为人民币 74,974.92 元。

截至清算结束日银行存款为人民币 1,866,960.47 元、结算备付金为人民币 9,865,995.62 元、存出保证金为人民币 74,974.92 元，该等资产于本次清算结束后支付应付管理人报酬、应付托管费、应交税费、审计费、律师费等其他负债。

3、 负债清偿情况

最后运作日应付管理人报酬为人民币 501,780.39 元、应付托管费为人民币 83,630.09 元、应交税费为人民币 10,721.18 元、应付利润为人民币 2,470,444.80 元、其他负债为人民币 211,799.35 元。

截至清算结束日应付管理人报酬为人民币 501,780.39 元、应付托管费为人民币 83,630.09 元、应交税费为人民币 10,721.18 元、其他负债为人民币 11,211,799.35 元。

已计提的审计费人民币 5,000.00 元，将于本次清算结束支付；应付管理人报酬人民币 501,780.39 元、应付托管费人民币 83,630.09 元等负债将在清算报告公示后全部偿还。

本集合计划管理人已于 2025 年 8 月 26 日向全部持有人划付支付赎回款（于 2025 年 8 月 26 日确认投资者赎回申请）人民币共计 1,774,338,236.65 元（其中净赎回款人民币 1,771,867,791.85 元，应付利润人民币 2,470,444.80 元）。

由于本集合计划结算备付金和存出保证金合计人民币 9,940,970.54 元被冻结，托管账户只剩下人民币 1,764,623,619.07 元，不足以向持有人派发本金和应付利润共计人民币 1,774,338,236.65 元，为了能及时将本集合计划的赎回款分配给投资者及支付应付利润、应付托管费、应交税费等费用，并能按期完成清算，故由东莞证券股份有限公司垫付自有资金人民币 11,000,000.00 元到本集合计划的托管账户。待收到中登公司结算备付金、存出保证金后返还。上述事项导致清算期间本集合计划产生其他负债人民币 11,000,000.00 元。

4、持有人权益情况

最后运作日持有人权益为人民币 1,771,867,791.85 元，清算结束日为人民币 0.00 元。

5、清算期间的清算损益情况

2025 年 08 月 26 日至 2025 年 08 月 27 日止清算期间	
单位：人民币元	
项目	
一、清算收益	0.00
二、清算费用	0.00
三、本期清算净收益	0.00
四、从持有人权益转入	1,771,867,791.85
五、累计清算净收益	1,771,867,791.85

6、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

截至清算结束日，本集合计划剩余资产为人民币 11,807,931.01 元（其中：银行存款为人民币 1,866,960.47 元、结算备付金为人民币 9,865,995.62 元、存出保证金为人民币 74,974.92 元），负债为人民币 11,807,931.01 元（其中：应付管

理人报酬为人民币 501,780.39 元、应付托管费为人民币 83,630.09 元、应交税费为人民币 10,721.18 元、其他负债为人民币 11,211,799.35 元），剩余所有者权益为人民币 0.00 元。

管理人垫付资金到账日起孳生的利息归本集合计划管理人所有。

本集合计划计提的银行存款利息收入和各项费用为合理估计金额，可能与实际支付金额存在微小差异。

7、集合计划财产清算报告的告知安排

清算报告已经托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后向集合计划份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

（1）东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划清算审计报告；

（2）《上海市通力律师事务所关于<东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划清算报告>的法律意见》。

2、存放地点

上述备查文本存放在本集合计划管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本集合计划管理人网站（<https://www.dgzq.com.cn>）查阅。

3、查阅方式

本报告存放在本集合计划管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划财产清算小组

2025 年 10 月 15 日